

DAILY SIGNAL

平成28年10月18日(火)
上田八木証券株式会社 TEL0120-327-017

§ 10/18 のオペと市場動向

8時発表の準備預金残高見込みは234兆円だった。
本日の無担保コールON物は、朝方▲0.03%の出合から始まり、
その後は▲0.065～▲0.03%のレンジで取引された。
後場に入っても地合いは変わらず、そのまま引けた。

	即日オペ種類	オファー額	準備残見込	所要対比
8:00	-	-	2,340,000	+2,340,000

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想				10/18 のオペ結果
	10/18(火)		10/19(水)		10/20(木)		10/21(金)		
券	+0		▲1,000		▲1,000		▲2,000		9:20 ノーオペ
財政	▲23,400		+2,000		▲22,000		+2,000		10:10 ノーオペ
過不足	▲23,400		+1,000		▲23,000		+0		10:40 ノーオペ
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	10:40 米ドル資金供給(10/20-10/27) 貸付利率0.910% 応札1百万米ドル
国債買入				+12,500					11:50 国債補完供給(10/18-10/19) ▲0.500% 全取 42億
国庫短期証券買入		+17,500							12:50 ノーオペ
国債買現先									13:00 ノーオペ
共通担保(本店)									14:45 米ドル資金供給用担保国債 供給(売現先)(10/19-10/28) ▲0.100% 全取 2億
共通担保(全店)	▲100		▲400						
CP買現先									
CP等買入	▲300					+1,000			
社債等買入	▲100								
ETF買入									
J-REIT買入									
被災地金融機関支援 貸出									
国債補完供給									
米ドル供給用担保国債供給									
成長基盤強化支援 貸出増加支援									
当座預金増減	▲6,400		+13,100		▲22,000		+100		
当座預金残高	3,141,100		3,154,200		3,132,200		3,132,300		
準備預金残高	2,822,200								
積み終了先	2,286,100		ノーオペ		ノーオペ		ノーオペ		共通担保(本店) 0
超過準備	2,247,200								共通担保(全店) 4,231
非準備先残高	318,900								国債買現先 0
準備預金進捗率	96.2%								CP買現先 0
平均	9.7%		予想込増減 +13,100		予想込増減 ▲22,000		予想込増減 +100		成長基盤強化 71,647
乖離率	86.6%		当預見込 3,154,200		当預見込 3,132,200		当預見込 3,132,300		被災地金融機関支援 4,880
									ロンバート残高 0

今 積み期間の所要準備額(積数) 2,153,500
10/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 81,200
10/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 2,900

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レボG.C
オファー	-	-	-0.100	-0.095
ビッド	-0.040	-	0.000	-0.085
出来値	-	-	-	-

(参考)日銀B/S(単位:兆円)	14年末実績	15年末実績	10/10
長期国債	202	282	344
CP等	2.2	2.2	1.9
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	3.8	6.9	10.0
J-REIT	0.18	0.27	0.34
貸出支援基金	25	31	35
国庫短期証券	49	43	56
その他とも資産計	300	383	460
銀行券	93	98	96
当座預金	178	253	309
その他とも負債・純資産計	300	383	460

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
10/18	640(1Y)	-0.3080%	-0.3219%
10/13	639(3M)	-0.2735%	-0.2925%
10/6	638(3M)	-0.3120%	-0.3274%

10/17 のコール市場残高(前日比)

	合計	有担	無担
	80,731	+250	-553

10/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,155,400

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.065	-	-	-	-0.033	-	-	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	-	-0.005	-	-	-	-	-	-
加重平均	-0.045	-	-	-0.025	-0.025	-	-0.033	-	-	-	-
東京レボ・レート	-0.085	-0.087	-	-0.090	-0.095	-0.099	-0.100	-	-0.158	-0.225	-0.232

§ 10/19 オファーのオペと市場動向予想

足許は▲0.07～+0.001%のレンジで取引されよう。
共通担保オペはノーオペを予想する。

10/19 の予定(国内)

市場調節に関する懇談会(日銀)

10/19 の予定(海外)

米 ヘッジブック
週間MBA住宅ローン申請指数
住宅着工件数(9月)

翌営業日の即日オペ予想				翌営業日の出合いレンジ予想								
即日オペ金額	当預増減	当預残高	所要対比	ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
◎ ノーオペ	+13,100	3,154,200	+3,154,200	-0.070	-0.035	-0.035	-0.035	-0.035	-0.035	-0.035	-0.070	-0.070
				~	~	~	~	~	~	~	~	~
				0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001	0.001

共通担保資金供給(全店)				*当日物			
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2016/10/17 ~ 2016/10/31	8,000	1,861	1,861	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/10/11 ~ 2016/10/24	8,000	2,010	2,010	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/10/7 ~ 2017/1/16	5,000	210	210	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/10/3 ~ 2016/10/17	8,000	1,910	1,910	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/9/26 ~ 2016/10/11	8,000	2,400	2,400	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/9/20 ~ 2016/10/3	8,000	4,540	4,540	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/9/12 ~ 2016/9/26	8,000	1,970	1,970	0.00%	固定金利	-	札割れ
2016/9/5 ~ 2016/9/20	8,000	1,660	1,660	0.00%	固定金利	-	札割れ

共通担保資金供給(本店)				*当日物			
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
2015/11/18 ~ 2015/11/19	1,000	19	19	0.10%	0.100%	-	札割れ
2012/6/5 ~ 2012/6/13	10,000	12,400	10,002	0.10%	0.100%	80.7%	1.24
2012/6/1 ~ 2012/6/15	10,000	27,035	10,005	0.10%	0.100%	37.0%	2.70
2012/4/20 ~ 2012/5/1	4,000	9,870	4,008	0.10%	0.100%	40.6%	2.46
米ドル資金供給オペ							
期間	オファー額	応札額	落札額	按分レート	平均レート	按分率	倍率
10/20 ~ 10/27	担保範囲内	1	1	0.910%	固定金利	-	1.00
10/14 ~ 10/20	担保範囲内	0	0	0.900%	固定金利	-	応札なし

本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。 上田八木証券株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第243号 加入協会 日本証券業協会